

Innlend verðbréf

Innlend skuldabréf	48,9%
Ríkisskuldabréf	26,6%
Sjóðfélagalán	12,0%
Reykjavík	1,6%
Lánasjóður sveitarfélaga	1,5%
Landsvirkjun	0,9%
Kaupping Banki hf.	0,9%
Kópavogur	0,7%
Icelandair Group hf.	0,6%
Skipti hf.	0,6%
Orkuveita Reykjavíkur	0,5%
Bleiksstaðir ehf. (veðskuldabréf)	0,4%
RARIK ohf.	0,3%
HS veitur hf.	0,3%
Akureyri	0,3%
Landsnet hf.	0,2%
Spölur ehf.	0,2%
Aðrir útgefendur lægri en 0,2% hver (10 útgefendur)	1,3%

Innlend hlutabréf

Innlend hlutabréf	2,2%
Jarðvarmi slhf.	0,7%
Úrval innlendra hlutabréfa - VÍB Sjóður 10	0,5%
Stefnir Real Estate I slhf.	0,3%
Aðrir útgefendur lægri en 0,1% hver (13 útgefendur)	0,6%

Innlendar framtaksfjárfestingar

Innlendar framtaksfjárfestingar	1,1%
Framtakssjóður Íslands slhf.	0,9%
Auður-I fagfjárfestastjóður slf.	0,2%

Laust fé

Laust fé	1,4%
-----------------	-------------

Erlend verðbréf

Erlend skuldabréf	5,8%
Vanguard US Government Bond Fund	2,9%
Vanguard Euro Government Bond Fund	2,3%
Önnur erlend skuldabréf	0,6%

Erlend hlutabréf

Erlend hlutabréf	37,5%
Vanguard Global Stock Index Fund	17,6%
Vanguard Global Enhanced Equity Fund	7,9%
Sparinvest Global Value Fund	4,1%
Wegelin Equity Active Indexing Fund	4,0%
Gartmore Global Focus Fund	2,0%
Skagen Global Fund	1,5%
Credit Suisse MSCI World	0,4%

Erlendar framtaksfjárfestingar

Erlendar framtaksfjárfestingar	11,2%
ICG - Mezzanine Fund 2006	3,8%
BlackRock - Vesey Street Fund III	1,6%
Morgan Stanley - Private Markets Fund III	1,6%
ICG - Mezzanine Fund 2003	1,4%
Morgan Stanley - Private Markets Fund IV	1,3%
BlackRock - Private Opportunities Fund II	0,6%
Credit Suisse - Merchant Banking Partners Fund IV	0,6%
Credit Suisse - Investment Partners Fund III	0,3%

Erlendur gjaldeyrir

Erlendur gjaldeyrir	2,5%
----------------------------	-------------

Varúðarniðurfærsla vegna afleiðusamninga, m. áföllnum dráttarvöxtum

Varúðarniðurfærsla vegna afleiðusamninga, m. áföllnum dráttarvöxtum	-10,6%
--	---------------

Innlend skuldabréf	48,9%
Innlend hlutabréf	2,2%
Innlendar framtaksfjárfestingar	1,1%
Erlend skuldabréf	5,8%
Erlend hlutabréf	37,5%
Erlendar framtaksfjárfestingar	11,2%
Laust fé	3,8%
Varúðarniðurfærsla vegna afleiðusamninga	-10,6%

Samtals	100,0%
----------------	---------------

Fyrirvarar:

Vakin er athygli á því að enn er nokkur óvissa um eignamat. Lífeyrissjóðurinn metur eignir safnsins með varúðarafskriftum þar sem tilefni þykir til og í samráði við endurskoðendur sjóðsins. Ljóst er að endanleg uppgjör krafna verða frábrugðin þeim varúðarafskriftum sem færðar hafa verið, í einhverjum tilfellum kunna endurheimtur að verða meiri og í einhverjum tilvikum minni.

Varúðarniðurfærsla er gerð vegna afleiðusamninga lífeyrissjóðsins og eru þeir færðir í bókum sjóðsins m.v. verstu mögulegu niðurstöðu ásamt áföllnum dráttarvöxtum. Þrátt fyrir að sjóðurinn hafi í varúðarskyni gjaldfært tap af samningunum með þessum hætti, er alveg óvíst hvort að sjóðnum beri lagaleg skylda að gera samningana upp og þá með hvaða hætti.

Gert er ráð fyrir að hluti skuldar vegna afleiðusamninga verði skuldajafnað á móti samþykktum kröfum á Glitni banka hf.